

# 关于举办首届“郑商所杯”大学生模拟交易大赛的通知

郑商发〔2018〕82号

为深入贯彻落实党的十九大和全国金融工作会议精神，响应将投资者教育纳入国民教育体系的号召，适应新形势下期货市场自身发展对人才的需求，郑州商品交易所（以下简称郑商所）联合中国期货业协会（以下简称中期协）举办首届“郑商所杯”大学生模拟交易大赛（以下简称“郑商所杯”）。现将有关事项通知如下。

## 一、主办单位

郑州商品交易所、中国期货业协会

## 二、参赛对象

本届大赛仅对全日制在校大学生开放，包括本科生、研究生（硕士、博士）。

## 三、参赛方式

本届大赛仅接受以个人形式报名参加。

## 四、时间安排

（一）报名时间：6月1日至8月31日。

（二）开赛时间：7月1日至9月30日。

## 五、注册报名

参赛者可通过“郑商所杯”大学生模拟交易大赛官网

(zcecup.czce.com.cn)、郑商所官网、中期协官网等渠道报名参赛。报名时，参赛者需提交参赛昵称、真实姓名、手机号码、身份证号码、学号、学校、学院、专业、年级、学生证扫描件等信息。

## 六、网络课堂

参赛者可以在大赛官网中学习专区栏目学习期货理论知识。

## 七、模拟交易

报名参赛后，参赛者可以在大赛官网个人中心获得模拟交易专用账号和密码，下载并登陆大赛专用交易软件即可进行模拟交易。

## 八、大赛规则

比赛主要包括交易能力测试和理论知识水平测试。交易能力测试以赛季内参加模拟交易的成绩为评定标准。理论知识水平测试以期货从业人员资格考试的成绩为评定标准。具体规则如下：

### （一）交易能力测试

1. 测试目的：考查参赛者平衡风险和收益的能力。
2. 账户初始虚拟保证金为 100 万元，开赛后第 45 个自然日再次补充 100 万元保证金，总计 200 万元。
3. 交易品种：郑商所已上市的所有品种，包括期货合约和期权合约。

4. 交易制度：交易时间、涨跌停板幅度、限仓标准等与郑商所实盘交易一致。合约将在其交割月前一个月的最后一个交易日收盘时停止交易。

5. 交易保证金按照郑商所标准的 2 倍收取。交易手续费按照郑商所标准的 1.5 倍收取。

6. 大赛最后一天，参赛者可以继续保留持仓，当日权益按照结算价计算，并以此权益进行评选。

7. 账户每月的活跃交易日应不小于 10 天。

8. 交易能力测试得分依据单位净值、最大回撤度、下半方差进行计算，具体计算方法见附件。

## （二）理论知识水平测试

1. 理论知识水平测试得分为附加分。如参赛者通过测试，将获得理论知识水平测试固定得分 10 分。

2. 理论知识水平测试采用中期协组织的期货从业人员资格考试，考试内容为“期货基础知识”和“期货法律法规”两门课程。

3. 如参赛者已通过期货从业人员资格考试，考试成绩在本次大赛中有效，可视为通过理论知识水平测试。尚未通过的参赛者可自行报名参加 2018 年 7 月 7 日或 9 月 8 日的期货从业人员资格考试。

4. 考试成绩以中期协提供数据为准。

## （三）综合评定

1. 最终成绩为交易能力测试得分和理论知识水平测试得分之和。

2. 如参赛者在交易能力测试环节存在舞弊行为，活动举办方将取消其评奖资格。

3. 如参赛者以虚假身份信息获得参赛资格，经查实后，活动举办方将取消其评奖资格。

## 九、奖项设置

大赛奖项根据参赛者综合得分进行评选，用以奖励大赛中表现最佳的参赛者。

本届大赛设立 4 个等级奖项，具体分为一等奖、二等奖、三等奖、优胜奖。其中，一等奖 10 名，二等奖 20 名，三等奖 60 名，优胜奖 100 名，共计 190 名（具体见表 1）。郑商所将根据实际情况对获奖人数进行调整。

表 1 首届“郑商所杯”大学生模拟交易大赛奖项设置

奖项名称	数量	奖励
一等奖	10 名	1. 郑商所与中期协联名证书 2. 现金 8000 元 3. 推荐金融机构实习机会
二等奖	20 名	1. 郑商所与中期协联名证书 2. 现金 5000 元 3. 推荐金融机构实习机会
三等奖	60 名	1. 郑商所与中期协联名证书 2. 现金 2000 元 3. 推荐金融机构实习机会
优胜奖	100 名	1. 郑商所与中期协联名证书 2. 现金 1000 元

注：奖金均为税前金额

一等奖、二等奖、三等奖的获奖者可获得：（1）郑商所与中期协联合颁发的证书；（2）现金奖励；（3）推荐郑商所、中期协以及其它金融机构实习机会。其中，一等奖奖励 8000 元，二等奖奖励 5000 元，三等奖奖励 2000 元。

优胜奖的获奖者可获得：（1）郑商所与中期协联合颁发的证书；（2）现金奖励。优胜奖奖励 1000 元。

## 十、参赛咨询

在报名及参赛过程中，如有问题，可查阅大赛官网、在大赛官网个人中心的参赛咨询模块提问、加入 QQ 群 763357394 或致电 0371-65611036 进行咨询。

附件：首届“郑商所杯”大学生模拟交易大赛评分指标计算方法

郑州商品交易所 中国期货业协会

2018 年 5 月 11 日

附件

## 首届“郑商所杯”大学生模拟交易大赛 评分指标计算方法

1. 单位净值 (Net Asset Value Per Share, NAVPS)

$$\text{单位净值} = \text{上期净值} \times \left( 1 + \frac{\text{当日权益} - \text{当日入金} + \text{当日出金} - \text{上期权益}}{\text{上期权益} + \text{当日入金}} \right)$$

2. 最大回撤 (Maximum Drawdown, MD)

$$\text{最大回撤} = \max \left( \frac{\text{历史最大净值} - \text{当日净值}}{\text{历史最大净值}} \right)$$

3. 下半方差 (Lower Semi-variance, LSV)

$$LSV_t = \frac{1}{n} \sum_1^n \left[ \left( NAVPS_t - \overline{NAVPS} \right)^- \right]^2$$

其中,  $NAVPS_t$  = 第 t 日该账户的单位净值,  $\overline{NAVPS}$  = 截至到计算日该账户的单位净值平均数。

4. 单位净值得分

$$Score_{NAVPS,i} = \left( \frac{NAVPS_i}{NAVPS_{\max}} \times 100 \right) \times 30\% + \left( \frac{n+1 - rank_i^{NAVPS}}{n} \times 100 \right) \times 70\%$$

其中,  $NAVPS_i$  = 第 i 个投资者的单位净值,  $NAVPS_{\max}$  = 所有账户的最大单位净值,  $n$  = 总账户数量,  $rank_i^{NAVPS}$  = 第 i 个账户的单位净值排名。

5. 回撤得分

$$Score_{MD,i} = \frac{n+1 - rank_i^{MD}}{n} \times 100$$

其中,  $n$  = 总账户数量,  $rank_i^{MD}$  = 第 i 个账户最大回撤的

排名。

## 6. 波动率得分

$$Score_{LSV,i} = \left[ \left( 1 - \frac{LSV_i}{LSV_{\max}} \right) \times 100 \right] \times 30\% + \left( \frac{n+1 - rank_i^{LSV}}{n} \times 100 \right) \times 70\%$$

其中， $LSV_i$  = 第  $i$  个账户的下半方差， $LSV_{\max}$  = 所有账户最大的下半方差， $n$  = 总账户数量， $rank_i^{LSV}$  = 第  $i$  个账户波动率的排名。

## 7. 交易能力测试得分

交易能力测试得分

$$= \text{单位净值得分} \times 50\% + \text{回撤得分} \times 20\% + \text{波动率得分} \times 30\%$$